

# 中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资 基金 2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 28 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料经审计，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	中金沪深 300	
基金主代码	003015	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 7 月 22 日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	21,119,484.86 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中金沪深 300A	中金沪深 300C
下属分级基金的交易代码:	003015	003579
报告期末下属分级基金的份额总额	19,033,286.38 份	2,086,198.48 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。
投资策略	本基金作为股票指数增强型发起式证券投资基金，股票投资策略为本基金的核心策略，通过复制目标股票指数作为基本投资组合以及量化增强策略考虑基本面与技术面等多种因素，找出具有相对于标的指数超额收益的相关量化因子，并根据因子对应的股票权重调整基本投资组合，最后对投资组合进行跟踪误差以及交易成本等相关优化。其他策略还包括债券投资策略和股指期货投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型发起式证券投资基金，属于较高预期风险、较高

	预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
--	---

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中金基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李虹	郭明
	联系电话	010-63211122	010-66105799
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-868-1166	95588
传真		010-66159121	010-66105798

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ciccfund.com/">http://www.ciccfund.com/</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指 标	2018 年		2017 年		2016 年 7 月 22 日(基金合同 生效日)-2016 年 12 月 31 日	
	中金沪深 300A	中金沪深 300C	中金沪深 300A	中金沪深 300C	中金沪深 300A	中金沪深 300C
本期已 实现收 益	-2,275,304.51	-281,193.80	1,714,984.58	36,101.30	431,226.04	0.62
本期利 润	-3,648,076.65	-334,963.33	1,938,549.67	36,552.23	248,200.89	-3.70
加权平 均基金 份额本 期利润	-0.2647	-0.2774	0.1834	0.2309	0.0247	-0.0394
本期基 金份额 净值增 长率	-19.85%	-19.75%	17.81%	18.75%	2.48%	-3.70%
3.1.2 期末数 据和指 标	2018 年末		2017 年末		2016 年末	
	期末可 供分配	-0.0323	-0.0234	0.2024	0.2117	0.0248

基金份 额利润						
期末基 金资产 净值	18,418,213.93	2,037,479.69	13,086,807.92	327,152.01	10,336,685.26	96.30
期末基 金份额 净值	0.9677	0.9766	1.2073	1.2169	1.0248	1.0248

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分孰低数；

4、本基金合同于 2016 年 7 月 22 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金沪深 300A

阶段	份额净值增 长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	-11.17%	1.43%	-11.83%	1.56%	0.66%	-0.13%
过去六个月	-12.54%	1.31%	-13.52%	1.42%	0.98%	-0.11%
过去一年	-19.85%	1.19%	-24.12%	1.27%	4.27%	-0.08%
自基金合同 生效起至今	-3.23%	0.90%	-6.90%	0.95%	3.67%	-0.05%

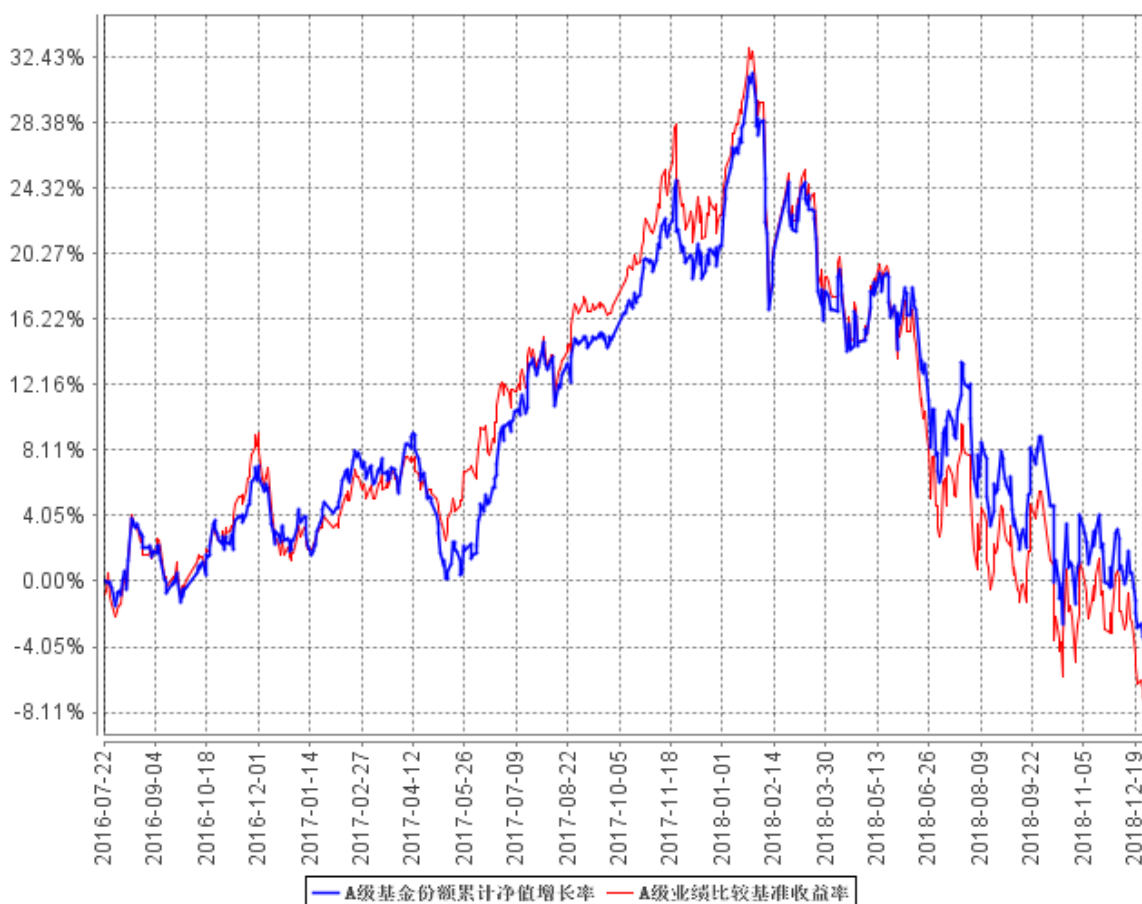
中金沪深 300C

阶段	份额净值增 长率①	份额净值 增长率标	业绩比较 基准收益	业绩比较基准 收益率标准差	①—③	②—④
----	--------------	--------------	--------------	------------------	-----	-----

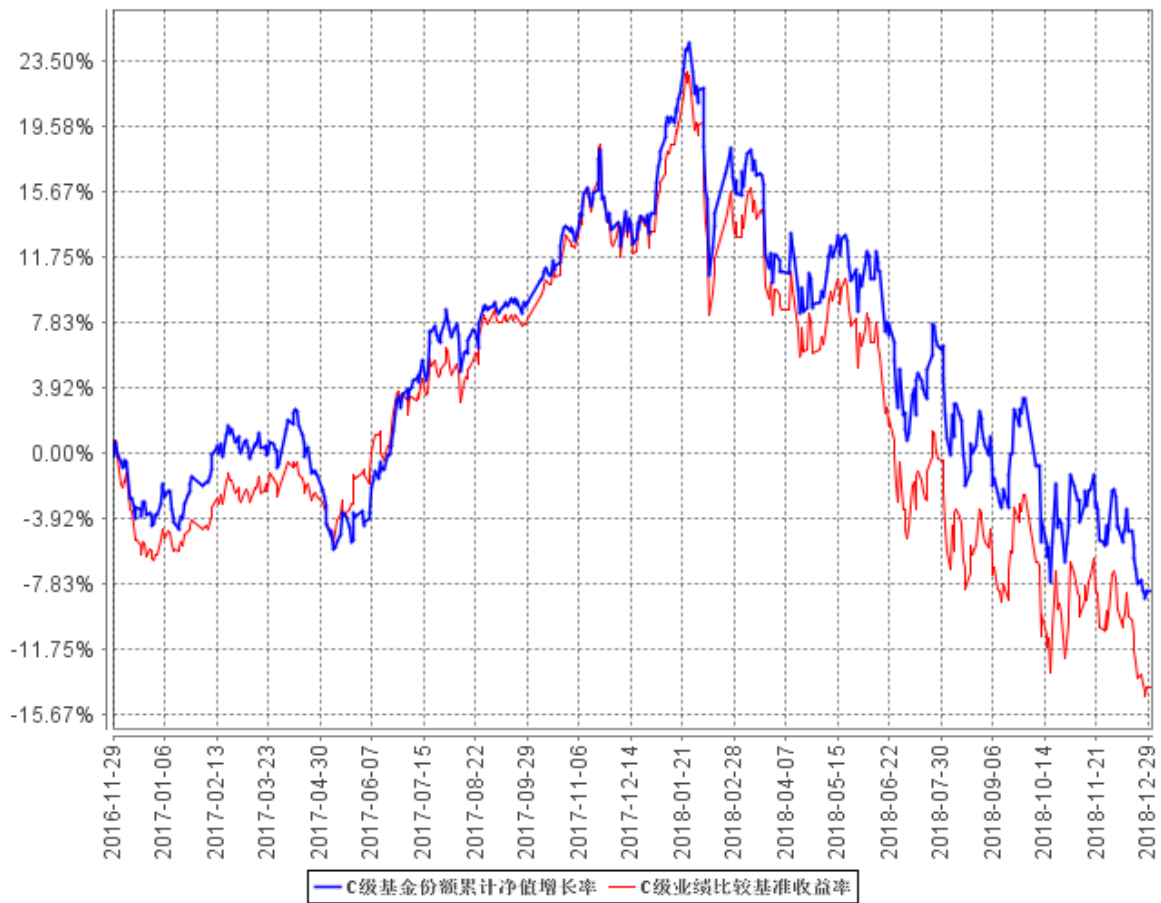
		准差②	率③	④		
过去三个月	-11.18%	1.43%	-11.83%	1.56%	0.65%	-0.13%
过去六个月	-12.61%	1.31%	-13.52%	1.42%	0.91%	-0.11%
过去一年	-19.75%	1.19%	-24.12%	1.27%	4.37%	-0.08%
自基金合同 生效起至今	-8.23%	0.94%	-14.00%	0.99%	5.77%	-0.05%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



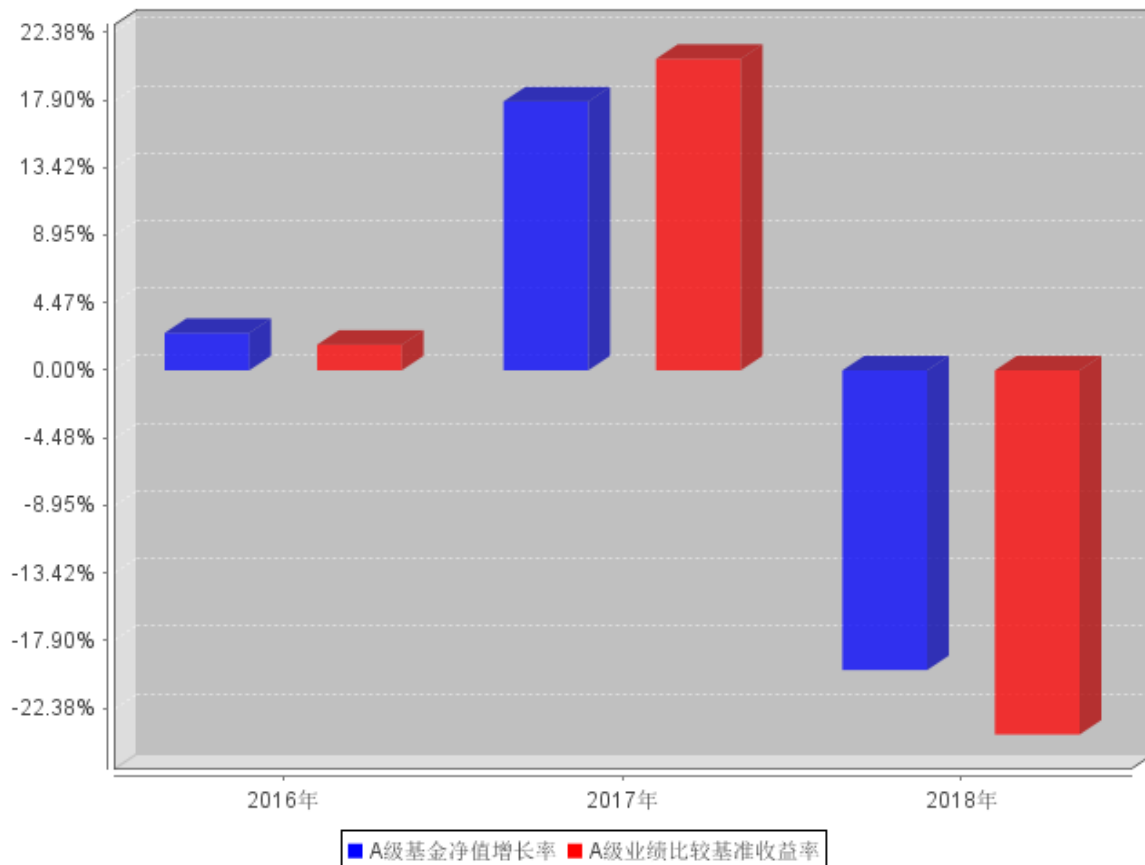
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



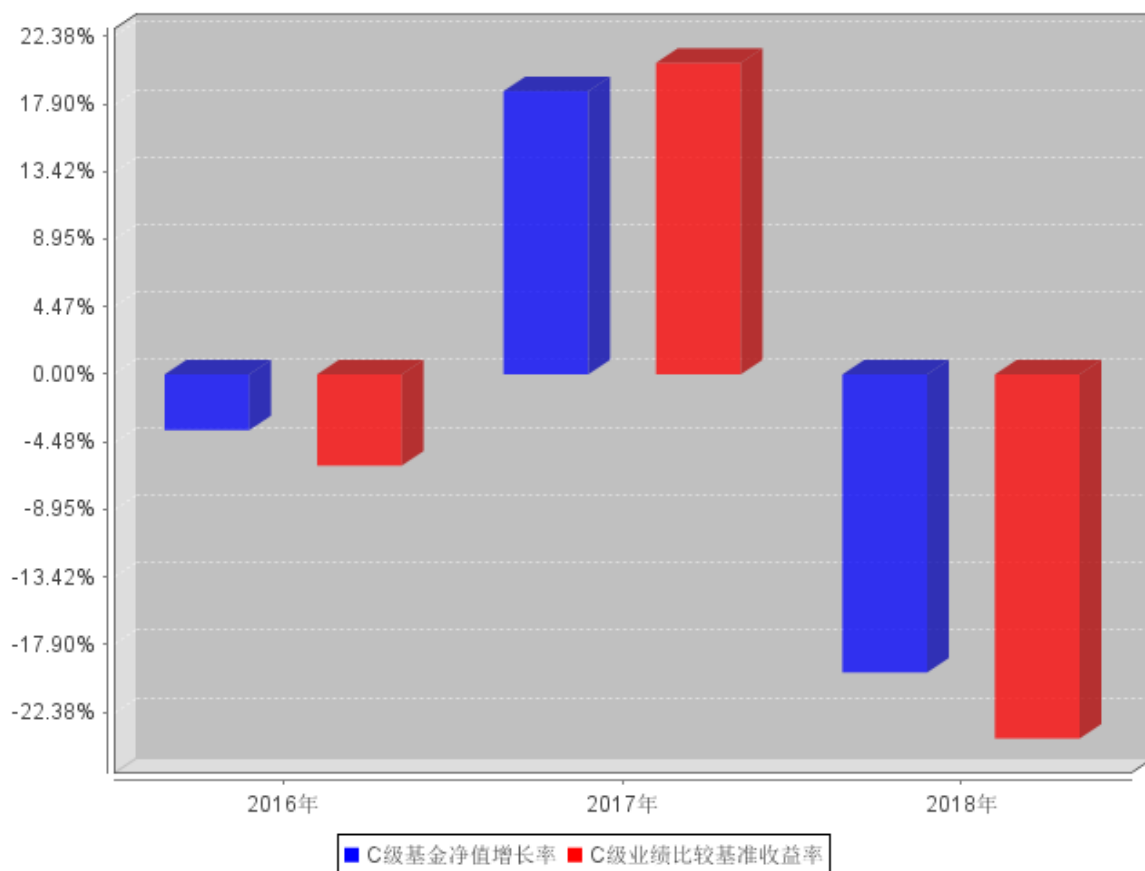


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日为 2016 年 7 月 22 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

根据基金相关法律法规和基金合同的要求，结合本基金实际运作情况，自成立以来本基金未进行收益分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”、“公司”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东，是首家单一股东发起设立持股的基金公司，注册资本 3.5 亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行，致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金充分发挥母公司品牌及资源优势，持续增强公司整体竞争实力。中金基金注册地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室，办公地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层。

截至 2018 年 12 月 31 日，公司共管理 27 只开放式基金，证券投资基金管理规模 153.48 亿。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏宇	本基金基金经理	2017 年 3 月 28 日	-	8 年	魏宇先生，统计学博士。2010 年 8 月至 2014 年 10 月，在北京尊嘉资产管理有限公司从事 A 股量化策略开发。2014 年 11 月加入公司，历任高级经理，量化专户投资经理，现任公司量化公募投资部基金经理。

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、本基金无基金经理助理。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订）的规定，制定了《中金基金管理有限公司公平交易管理办法》，对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易实施效果评估、信息披露与报告制度等多方面进行了规定，公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。为保证各投资组合在投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，公司建立了科学合理的投资运作体系和规范的投资流程，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，规范投资、研究和交易等各相关流程，通过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内，本基金采用量化模型进行选股来增强指数。2018 年指数跌幅较大，本基金虽然也随指数下跌，但还是获取了一定的超额收益。新的模型在不断地研发和更新中，我们会努力在控制跟踪误差的情况下力争带来更多的超额收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金沪深 300A 基金份额净值为 0.9677 元，本报告期基金份额净值增长率为-19.85%；截至本报告期末中金沪深 300C 基金份额净值为 0.9766 元，本报告期基金份额净值增长率为-19.75%；同期业绩比较基准收益率为-24.12%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年中国经济的形势较为严峻。第一 A 股上市公司盈利同比增速在 2018 年上半年见顶后开始向下，短期的经济下行压力较大。第二经济结构性调整和升级，在短期对市场造成一定的压力。第三中美贸易摩擦带来国际政治经济环境的不稳定性上升，中国经济发展的外部环境形势不容乐观。2018 年 A 股市场惨淡收官，全年上证 50 指数下跌 19.83%，沪深 300 指数下跌 25.31%，中证 500 指数下跌 33.32%，创业板指下跌 28.65%。展望 2019 年，中国经济增长在国际周期及国内因素共同作用下可能继续下行，尽管 2018 年下半年至今市场预期已经在调低，但是考虑到增长下行风险仍未体现充分，2019 年股票资产仍可能承受较大压力。在 2019 年最初的 1 个多月里，A 股各大指数都有较大幅度的反弹，这主要是因为中美贸易谈判呈现出乐观的预期以及 2018 年的下跌已经使多个指数的估值处于历史低位。这就更加说明了以中美关系为代表的国际政治经济环境是影响中国经济以及 A 股市场的重要因素，2019 年必须密切关注并迅速反应。如果中美谈判取得阶段性成果，那么必须认真分析其对各个行业的影响。而对个股而言，其自身的业绩以及随之而来的估值、成长预期等指标将成为影响其股价在行业中相对表现的重要指标。2019 年风险和机遇共存。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和内部稽核工作，强化制度完善及对制度执行情况的监督检查，根据不同的基金特点与发展情况，及时界定新的风险点，评价风险级别，并纳入稽核计划，有效保证了基金管理运作及公司各项业务的合法合规和稳健有序。本报告期内，本基金管理人有关本基金的监察稽核主要工作如下：

1) 本基金管理人以中国证监会《季度监察稽核项目表》为基础, 对本基金的投资、研究、交易、基金会计、注册登记、营销、宣传推介等重要业务进行每季度的风险自查, 及定期进行有重点的检查。2) 研究、投资交易环节, 本基金管理人对投资对象建立筛选流程、对投资对象池(库)进行日常维护与更新, 并对基金的投资比例进行日常监控, 对关联交易进行日常维护, 定期关注基金持仓流动性风险, 并对公平交易执行情况进行检查等。3) 营销与销售方面, 本基金管理人对本基金宣传推介材料、销售服务协议的合规性等进行检查, 同时加强对基金销售部门的合规培训。4) 基金运作保障方面, 本基金管理人通过加强对注册登记业务、基金会计业务、资金清算业务的检查力度, 保证基金运营安全、准确。5) 法律合规方面, 本基金管理人对公司制度规范、合同协议、产品方案、对外文件等进行合规性审核。6) 信息披露方面, 本基金管理人严格按照《证券投资基金信息披露管理办法》的规定, 认真做好本基金的信息披露工作, 确保信息披露内容的真实、准确、完整、及时。此外, 本基金管理人对监察稽核工作流程进行了完善和优化, 并按照既定的稽核计划开展内部稽核, 对检查出来的问题及时提出改进意见并督促相关部门有效落实。

报告期内, 本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规, 内部控制和风险防范措施逐步完善, 保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发, 提高监察稽核工作的有效性。

报告期内, 本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规, 内部控制和风险防范措施逐步完善, 保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发, 提高监察稽核工作的有效性。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内, 本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定, 日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行, 基金份额净值由基金管理人完成估值后, 经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会, 委员由公司总经理、分管运营领导、研究部、基金运营部、风险管理部、监察稽核部等相关人员组成, 负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员会和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内, 基金经理参加估值委员会会议, 但不介入基金日常估值业务; 参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议, 由其按约定提供债券品种的估值数据。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同中对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

#### **4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本基金为发起式基金，截止本报告期末，本基金成立未满三年。《公开募集证券投资基金运作管理办法》关于基金份额持有人数量及基金资产净值的限制性条款暂不适用于本基金。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金的管理人——中金基金管理有限公司在中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中金基金管理有限公司编制和披露的中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2018 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。



## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 1901209 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的第 1 页至第 35 页的中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“中金沪深 300 指数增强基金”）财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表、2018 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了中金沪深 300 指数增强基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果及基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中金沪深 300 指数增强基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	中金沪深 300 指数增强基金管理人中金基金管理有限公司管理层对其他信息负责。其他信息包括中金沪深 300 指数增强基金 2018 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的

	<p>情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>中金沪深 300 指数增强基金管理人中金基金管理有限公司管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，中金沪深 300 指数增强基金管理人中金基金管理有限公司管理层负责评估中金沪深 300 指数增强基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非中金沪深 300 指数增强基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>中金沪深 300 指数增强基金管理人中金基金管理有限公司治理层负责监督中金沪深 300 指数增强基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价中金沪深 300 指数增强基金管理人中金基金管理有限公司</p>

	<p>司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对中金沪深 300 指数增强基金管理人中金基金管理有限公司管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中金沪深 300 指数增强基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中金沪深 300 指数增强基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与中金沪深 300 指数增强基金管理人中金基金管理有限公司治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	奚霞   刘珊珊
会计师事务所的地址	中国北京东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层
审计报告日期	2019 年 3 月 27 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		212,720.66	1,107,014.41
结算备付金		73,791.19	89,378.41
存出保证金		2,911.74	6,442.42
交易性金融资产		20,478,278.91	12,583,740.46
其中：股票投资		19,373,438.91	12,583,740.46
基金投资		-	-
债券投资		1,104,840.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		309,835.69	108,290.50
应收利息		30,852.55	270.47
应收股利		-	-
应收申购款		5,298.70	18,987.01
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		21,113,689.44	13,914,123.68
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>

<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		500,000.00	-
应付证券清算款		-	252,838.51
应付赎回款		28,701.24	-
应付管理人报酬		7,908.73	5,666.74
应付托管费		2,372.64	1,700.04
应付销售服务费		666.91	715.57
应付交易费用		57,616.41	178,705.03
应交税费		-	-
应付利息		-51.82	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		60,781.71	60,537.86
负债合计		657,995.82	500,163.75
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		21,119,484.86	11,108,131.19
未分配利润		-663,791.24	2,305,828.74
所有者权益合计		20,455,693.62	13,413,959.93
负债和所有者权益总计		21,113,689.44	13,914,123.68

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，中金沪深 300A 基金份额净值 0.9677 元，基金份额总额 19,033,286.38 份；中金沪深 300C 基金份额净值 0.9766 元，基金份额总额 2,086,198.48 份。中金沪深 300 份额总额合计为 21,119,484.86 份。

## 7.2 利润表

会计主体：中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-3,595,814.90	2,566,372.75
1.利息收入		27,040.85	8,909.66
其中：存款利息收入		4,933.68	8,909.66
债券利息收入		22,107.17	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,212,068.53	2,321,060.78
其中：股票投资收益		-2,572,421.63	2,164,202.94
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-104.49	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		360,457.59	156,857.84
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-1,426,541.67	224,016.02
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		15,754.45	12,386.29
<b>减：二、费用</b>		387,225.08	591,270.85
1. 管理人报酬		83,239.98	59,401.58
2. 托管费		24,972.07	17,820.45
3. 销售服务费		5,220.49	715.57
4. 交易费用		209,004.62	440,492.43

5. 利息支出		1,099.21	-
其中：卖出回购金融资产支出		1,099.21	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用		63,688.71	72,840.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,983,039.98	1,975,101.90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,983,039.98	1,975,101.90

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	11,108,131.19	2,305,828.74	13,413,959.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,983,039.98	-3,983,039.98
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	10,011,353.67	1,013,420.00	11,024,773.67
其中：1. 基金申购款	14,300,027.63	1,528,329.37	15,828,357.00
2. 基金赎回款	-4,288,673.96	-514,909.37	-4,803,583.33

五、期末所有者权益（基金净值）	21,119,484.86	-663,791.24	20,455,693.62
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	10,086,780.86	250,000.70	10,336,781.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,975,101.90	1,975,101.90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,021,350.33	80,726.14	1,102,076.47
其中：1. 基金申购款	3,290,166.43	397,927.20	3,688,093.63
2. 基金赎回款	-2,268,816.10	-317,201.06	-2,586,017.16
五、期末所有者权益（基金净值）	11,108,131.19	2,305,828.74	13,413,959.93

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
孙菁

\_\_\_\_\_  
张纳

\_\_\_\_\_  
白娜

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）依据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于 2016 年 7 月 5 日证监许可 [2016] 1516 号《关于准予中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由中金基金管理有限公司（以下简称“中



金基金”) 依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式指数型基金, 存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金, 托管人为中国工商银行股份有限公司 (以下简称“工商银行”)。

本基金通过中金基金直销中心、中国国际金融股份有限公司 (“中金公司”) 及中国中投证券有限责任公司 (“中投证券”) 公开发售, 募集期为 2016 年 7 月 18 日。经向中国证监会备案, 《中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2016 年 7 月 22 日正式生效, 合同生效日基金实收份额为 10,001,300.00 份, 发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙) 审验并出具验资报告。

本基金根据认购 / 申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同, 将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用, 在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额, 称为 A 类基金份额; 从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用, 在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额, 称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金销售费用的不同, 本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值, 计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和《中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定, 本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金, 在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上, 通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制, 力争实现超越目标指数的投资收益, 谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%, 年化跟踪误差不超过 8.0%。本基金投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股。此外, 为更好地实现投资目标, 本基金可少量投资于部分非成分股 (包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、衍生工具 (权证、股指期货等)、债券资产 (国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、债券回购、银行存款等固定收益类资产, 以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具 (但须符合中国证监会的相关规定)。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部 (以下简称“财政部”) 颁布的企业会计准则的要求, 同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号 <年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券

《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况、2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本期未发生重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本期未发生重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本期未发生重大会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2002] 128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《财政部 国家税务总局 证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税 [2016] 70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通

知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(1) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(2) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称“营改增”）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称“管理人”）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(3) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。

(5) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(6) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(7) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

中金基金管理有限公司(“中金基金”)	基金管理人、基金发起人、基金注册登记机构及基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人
中国国际金融股份有限公司(“中金公司”)	基金管理人的股东, 基金销售机构
中国中投证券有限责任公司(“中投证券”)	基金管理人股东的一级全资子公司、基金销售机构
中金资本运营有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中金浦成投资有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中金期货有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司
中国国际金融(香港)有限公司	基金管理人股东的一级全资子公司

注：1、本基金本报告期关联方未发生变化。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期与上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 7.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期与上年度可比期间未通过关联方的交易单元进行权证交易。

###### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间均无应付关联方的佣金。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	83,239.98	59,401.58
其中：支付销售机构的客户维护费	6,256.53	1,261.91

注：支付基金管理人中金基金的基金管理费按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	24,972.07	17,820.45

注：支付基金托管人工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金沪深 300A	中金沪深 300C	合计
中金基金	-	132.90	132.90
中金公司	-	43.29	43.29
合计	-	176.19	176.19
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	中金沪深 300A	中金沪深 300C	合计
中金基金	-	101.68	101.68
合计	-	101.68	101.68

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；本基金 C 类基金份额收取销售服务费。支付基金销售机构的 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：本基金 C 类基金日基金销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.40% / 当年天数。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期与上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	中金沪深 300A	中金沪深 300C
基金合同生效日（2016 年 7 月 22 日）持有的基金份额	10,000,000.00	-
期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	52.54%	-

项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	中金沪深 300A	中金沪深 300C
基金合同生效日（2016	10,000,000.00	-

年 7 月 22 日 ) 持有的基金份额		
期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	92.26%	-

#### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方在本年末及上期末未持有本基金。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	212,720.66	3,640.89	1,107,014.41	6,438.92

注：本基金通过“工商银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金和存出保证金，于2018年12月31日的相关余额为人民币76,702.93元（2017年12月31日：人民币95,820.83元），当年产生的利息收入为人民币1,292.79元（上年度可比期间产生的利息收入为人民币2,470.74元）。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期与上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

#### 7.4.9 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

根据《证券发行与承销管理办法》，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上

市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600030	中信证券	2018 年 12 月 25 日	重大事项停牌	16.01	2019 年 1 月 10 日	17.15	8,500	147,258.06	136,085.00	-

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有因银行间债券正回购交易而作为抵押的债券。

##### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 500,000.00 元，于 2019 年 1 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)以公允价值计量的金融工具

(a)以公允价值计量的资产和负债

下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；



第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

单位：人民币元

持续的公允价值 计量资产	本期末 (错误!未找到引用源。12月31日)			
	合计	第一层次	第二层次	第三层次
交易性金融资产				
- 股票投资	19,373,438.91	19,237,353.91	136,085.00	-
- 债券投资	1,104,840.00	-	1,104,840.00	-
- 基金投资	-	-	-	-
- 资产支持证券投资	-	-	-	-
持续以公允价值计量的资产总额	20,478,278.91	19,237,353.91	1,240,925.00	-

单位：人民币元

持续的公允价值 计量资产	上年度末 (错误!未找到引用源。12月31日)			
	合计	第一层次	第二层次	第三层次
交易性金融资产				
- 股票投资	12,583,740.46	12,133,811.69	449,928.77	-
- 债券投资	-	-	-	-
- 基金投资	-	-	-	-
- 资产支持证券投资	-	-	-	-
持续以公允价值计量的资产总额	12,583,740.46	12,133,811.69	449,928.77	-

注：于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的流通受限的证券由于公开价格无法正常获取而列入第二层次或第三层次，账面价值为人民币 136,085.00 元（2017 年 12 月 31 日：人民币 449,928.77 元）。于 2018 年 12 月 31 日及 2017 年 12 月 31 日，本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具的三个层次之间没有发生重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

#### (b) 第二层次及第三层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售

期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具 (2017 年 12 月 31 日：无)。

(2)其他金融工具的公允价值 (期末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产款和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	19,373,438.91	91.76
	其中：股票	19,373,438.91	91.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,104,840.00	5.23
	其中：债券	1,104,840.00	5.23
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	286,511.85	1.36
8	其他各项资产	348,898.68	1.65
9	合计	21,113,689.44	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	779,008.76	3.81
C	制造业	7,262,119.84	35.50

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	796,950.00	3.90
E	建筑业	348,101.00	1.70
F	批发和零售业	596,981.53	2.92
G	交通运输、仓储和邮政业	639,885.68	3.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	191,514.00	0.94
J	金融业	7,173,629.24	35.07
K	房地产业	1,096,076.86	5.36
L	租赁和商务服务业	390,612.00	1.91
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	49,872.00	0.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	48,688.00	0.24
S	综合	-	-
	合计	19,373,438.91	94.71

### 8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有划分为积极投资的股票资产。

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票资产。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	23,200	1,301,520.00	6.36
2	000651	格力电器	28,077	1,002,068.13	4.90
3	601166	兴业银行	52,558	785,216.52	3.84
4	600016	民生银行	123,781	709,265.13	3.47
5	600585	海螺水泥	18,916	553,860.48	2.71
6	601328	交通银行	87,485	506,538.15	2.48
7	600028	中国石化	90,600	457,530.00	2.24
8	600031	三一重工	49,645	414,039.30	2.02
9	601818	光大银行	111,206	411,462.20	2.01
10	601006	大秦铁路	47,716	392,702.68	1.92

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

### 8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有划分为积极投资的股票资产。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	2,460,195.62	18.34
2	000651	格力电器	2,065,045.32	15.39
3	600887	伊利股份	1,505,699.00	11.22
4	601166	兴业银行	1,437,888.00	10.72
5	600104	上汽集团	1,208,492.00	9.01
6	600016	民生银行	1,190,829.00	8.88

7	000858	五 粮 液	1,134,817.00	8.46
8	600031	三一重工	1,057,607.00	7.88
9	600000	浦发银行	1,037,966.00	7.74
10	601009	南京银行	990,644.00	7.39
11	600028	中国石化	990,245.00	7.38
12	600585	海螺水泥	982,267.00	7.32
13	601328	交通银行	944,052.00	7.04
14	601818	光大银行	936,112.00	6.98
15	601006	大秦铁路	917,834.00	6.84
16	600383	金地集团	867,741.00	6.47
17	000568	泸州老窖	849,031.82	6.33
18	601601	中国太保	847,769.00	6.32
19	600519	贵州茅台	804,751.00	6.00
20	002304	洋河股份	803,133.00	5.99
21	600919	江苏银行	797,785.00	5.95
22	601988	中国银行	788,119.00	5.88
23	601888	中国国旅	773,731.00	5.77
24	000338	潍柴动力	757,095.00	5.64
25	601169	北京银行	756,146.00	5.64
26	000333	美的集团	748,529.00	5.58
27	000898	鞍钢股份	734,081.00	5.47
28	002024	苏宁易购	713,391.00	5.32
29	600019	宝钢股份	691,770.00	5.16
30	600015	华夏银行	678,279.00	5.06
31	600741	华域汽车	675,935.00	5.04
32	000069	华侨城A	672,424.00	5.01
33	600886	国投电力	651,674.00	4.86
34	600690	青岛海尔	643,764.00	4.80

35	000423	东阿阿胶	623,025.00	4.64
36	000100	TCL 集团	620,598.00	4.63
37	601088	中国神华	606,323.00	4.52
38	600089	特变电工	604,868.00	4.51
39	000002	万科 A	592,097.00	4.41
40	601288	农业银行	585,947.00	4.37
41	600170	上海建工	584,837.00	4.36
42	002146	荣盛发展	581,085.00	4.33
43	600036	招商银行	580,832.00	4.33
44	600674	川投能源	579,521.00	4.32
45	601211	国泰君安	573,502.37	4.28
46	600795	国电电力	571,797.00	4.26
47	601668	中国建筑	571,335.00	4.26
48	600606	绿地控股	569,954.00	4.25
49	600376	首开股份	563,398.69	4.20
50	000625	长安汽车	562,386.00	4.19
51	600352	浙江龙盛	558,211.00	4.16
52	601229	上海银行	554,567.00	4.13
53	601607	上海医药	550,272.00	4.10
54	600340	华夏幸福	527,718.00	3.93
55	000001	平安银行	527,092.00	3.93
56	600153	建发股份	518,141.00	3.86
57	600332	白云山	512,960.00	3.82
58	600030	中信证券	512,335.00	3.82
59	600219	南山铝业	498,599.70	3.72
60	002294	信立泰	491,019.00	3.66
61	600820	隧道股份	490,077.00	3.65
62	000157	中联重科	471,605.00	3.52

63	600177	雅戈尔	470,784.87	3.51
64	600688	上海石化	467,314.00	3.48
65	600900	长江电力	451,857.00	3.37
66	600208	新湖中宝	451,523.00	3.37
67	000425	徐工机械	444,365.00	3.31
68	000876	新希望	442,727.00	3.30
69	600048	保利地产	442,142.00	3.30
70	600276	恒瑞医药	439,412.00	3.28
71	600837	海通证券	433,455.00	3.23
72	002142	宁波银行	431,096.00	3.21
73	600066	宇通客车	426,997.00	3.18
74	000725	京东方A	422,000.00	3.15
75	600660	福耀玻璃	416,745.00	3.11
76	000826	启迪桑德	410,994.16	3.06
77	601186	中国铁建	406,935.00	3.03
78	000671	阳光城	401,842.00	3.00
79	600705	中航资本	394,653.00	2.94
80	601997	贵阳银行	394,423.00	2.94
81	002508	老板电器	391,091.00	2.92
82	600704	物产中大	389,509.00	2.90
83	000623	吉林敖东	387,245.00	2.89
84	603858	步长制药	376,915.00	2.81
85	601155	新城控股	375,859.00	2.80
86	000413	东旭光电	357,897.00	2.67
87	000402	金融街	356,376.00	2.66
88	002572	索菲亚	353,932.00	2.64
89	600369	西南证券	351,643.00	2.62
90	300027	华谊兄弟	349,209.00	2.60



91	600518	康美药业	345,245.00	2.57
92	601117	中国化学	343,331.00	2.56
93	600068	葛洲坝	332,966.00	2.48
94	000895	双汇发展	327,679.20	2.44
95	601788	光大证券	324,069.67	2.42
96	002415	海康威视	321,490.00	2.40
97	600221	海航控股	315,406.00	2.35
98	002385	大北农	314,435.00	2.34
99	600926	杭州银行	313,502.71	2.34
100	601225	陕西煤业	306,984.00	2.29
101	601377	兴业证券	304,716.00	2.27
102	600309	万华化学	301,631.00	2.25
103	002202	金风科技	296,949.00	2.21
104	600023	浙能电力	295,252.00	2.20
105	300144	宋城演艺	291,883.00	2.18
106	600739	辽宁成大	291,399.40	2.17
107	601628	中国人寿	291,307.00	2.17
108	000627	天茂集团	283,830.00	2.12
109	001979	招商蛇口	279,531.00	2.08
110	601898	中煤能源	279,097.00	2.08
111	600011	华能国际	276,412.00	2.06
112	000538	云南白药	276,344.00	2.06
113	002007	华兰生物	272,391.00	2.03
114	601021	春秋航空	270,185.00	2.01

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净
----	------	------	----------	----------

				值比例 (%)
1	000651	格力电器	1,222,328.74	9.11
2	600887	伊利股份	1,187,532.86	8.85
3	601288	农业银行	1,056,967.14	7.88
4	000338	潍柴动力	1,018,101.00	7.59
5	600519	贵州茅台	1,008,289.24	7.52
6	601988	中国银行	892,524.99	6.65
7	601318	中国平安	859,013.00	6.40
8	600104	上汽集团	845,908.56	6.31
9	601668	中国建筑	823,490.08	6.14
10	000333	美的集团	814,718.90	6.07
11	601006	大秦铁路	791,979.01	5.90
12	000568	泸州老窖	783,016.47	5.84
13	601166	兴业银行	778,251.38	5.80
14	000858	五粮液	748,327.00	5.58
15	002304	洋河股份	732,546.05	5.46
16	600886	国投电力	731,214.92	5.45
17	601186	中国铁建	726,561.23	5.42
18	601818	光大银行	720,483.37	5.37
19	000898	鞍钢股份	703,722.17	5.25
20	601088	中国神华	700,890.00	5.23
21	000725	京东方A	691,404.34	5.15
22	600031	三一重工	681,283.93	5.08
23	002146	荣盛发展	679,330.69	5.06
24	600000	浦发银行	677,731.28	5.05
25	600688	上海石化	670,229.72	5.00
26	601601	中国太保	662,996.74	4.94
27	600606	绿地控股	659,727.73	4.92

28	002024	苏宁易购	656,025.00	4.89
29	600383	金地集团	630,186.98	4.70
30	601328	交通银行	628,820.02	4.69
31	601888	中国国旅	614,901.00	4.58
32	601009	南京银行	611,252.00	4.56
33	601211	国泰君安	606,596.15	4.52
34	600919	江苏银行	599,622.00	4.47
35	600690	青岛海尔	581,938.04	4.34
36	600089	特变电工	572,856.61	4.27
37	000876	新希望	564,370.79	4.21
38	600016	民生银行	548,581.47	4.09
39	600028	中国石化	547,341.30	4.08
40	600219	南山铝业	542,372.60	4.04
41	600340	华夏幸福	541,318.00	4.04
42	600177	雅戈尔	540,609.43	4.03
43	600036	招商银行	539,155.00	4.02
44	600066	宇通客车	535,706.47	3.99
45	000002	万科 A	531,534.81	3.96
46	000001	平安银行	530,872.59	3.96
47	000100	TCL 集团	527,534.77	3.93
48	000625	长安汽车	521,912.36	3.89
49	600332	白云山	520,407.94	3.88
50	601155	新城控股	517,440.59	3.86
51	600309	万华化学	516,695.55	3.85
52	600376	首开股份	510,944.84	3.81
53	600674	川投能源	495,114.20	3.69
54	600585	海螺水泥	491,041.55	3.66
55	000423	东阿阿胶	481,862.00	3.59

56	600741	华域汽车	480,255.54	3.58
57	601225	陕西煤业	458,435.45	3.42
58	600153	建发股份	456,819.33	3.41
59	600820	隧道股份	454,363.00	3.39
60	000069	华侨城A	434,898.18	3.24
61	002385	大北农	434,145.38	3.24
62	600170	上海建工	419,677.00	3.13
63	600015	华夏银行	413,531.71	3.08
64	002294	信立泰	405,460.61	3.02
65	600535	天士力	405,208.34	3.02
66	000895	双汇发展	405,158.03	3.02
67	600208	新湖中宝	401,138.56	2.99
68	002008	大族激光	374,550.96	2.79
69	600705	中航资本	371,133.49	2.77
70	600023	浙能电力	369,782.45	2.76
71	000157	中联重科	368,589.05	2.75
72	600795	国电电力	366,781.00	2.73
73	600030	中信证券	360,321.00	2.69
74	601628	中国人寿	355,373.36	2.65
75	000413	东旭光电	353,596.46	2.64
76	603858	步长制药	351,349.32	2.62
77	600660	福耀玻璃	346,290.00	2.58
78	601169	北京银行	345,216.00	2.57
79	002142	宁波银行	344,253.00	2.57
80	600352	浙江龙盛	344,232.30	2.57
81	600390	五矿资本	344,136.04	2.57
82	601607	上海医药	343,799.00	2.56
83	002236	大华股份	342,979.95	2.56

84	600068	葛洲坝	342,862.57	2.56
85	000623	吉林敖东	342,585.56	2.55
86	002508	老板电器	341,817.00	2.55
87	600019	宝钢股份	341,615.52	2.55
88	600837	海通证券	340,422.19	2.54
89	600704	物产中大	337,238.89	2.51
90	000671	阳光城	337,158.00	2.51
91	002027	分众传媒	330,566.36	2.46
92	601991	大唐发电	328,006.10	2.45
93	000402	金融街	323,547.06	2.41
94	600048	保利地产	321,582.00	2.40
95	601117	中国化学	321,417.64	2.40
96	601997	贵阳银行	316,338.50	2.36
97	600373	中文传媒	311,571.87	2.32
98	600900	长江电力	310,769.49	2.32
99	601229	上海银行	304,912.00	2.27
100	000425	徐工机械	303,431.23	2.26
101	300144	宋城演艺	299,561.00	2.23
102	600369	西南证券	298,626.00	2.23
103	002065	东华软件	292,222.15	2.18
104	600276	恒瑞医药	290,363.51	2.16
105	601788	光大证券	288,757.62	2.15
106	000826	启迪桑德	287,874.00	2.15
107	002007	华兰生物	287,592.68	2.14
108	300027	华谊兄弟	287,554.00	2.14
109	002415	海康威视	278,467.00	2.08
110	001979	招商蛇口	276,772.00	2.06
111	600221	海航控股	276,016.29	2.06

112	600518	康美药业	274,787.00	2.05
113	601021	春秋航空	273,993.00	2.04
114	600011	华能国际	271,730.00	2.03

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	86,599,888.77
卖出股票收入（成交）总额	75,813,107.02

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,104,840.00	5.40
	其中：政策性金融债	1,104,840.00	5.40
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,104,840.00	5.40

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值
----	------	------	-------	------	---------

					比例 (%)
1	018005	国开 1701	11,000	1,104,840.00	5.40

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1

本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，除兴业银行（601166）、民生银行（600016）、交通银行（601328）、光大银行（601818）外，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也

没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2018年5月4日,中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书(银保监银罚决字(2018)1号),对兴业银行重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告;非真实转让信贷资产;无授信额度或超授信额度办理同业业务;内控管理严重违反审慎经营规则,多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规;同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保;债券卖出回购业务违规出表;个人理财资金违规投资;提供日期倒签的材料;部分非现场监管统计数据与事实不符;个别董事未经任职资格核准即履职;变相批量转让个人贷款;向四证不全的房地产项目提供融资等违法违规事实进行处罚。

2018年12月7日,中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书(银保监银罚决字(2018)12号),对交通银行不良信贷资产未洁净转让、理财资金投资本行不良信贷资产收益权;未尽调查并使用自有资金垫付承接风险资产;档案管理不到位、内控管理存在严重漏洞;理财资金借助保险资管渠道虚增本行存款规模;违规向土地储备机构提供融资;信贷资金违规承接本行表外理财资产;理财资金违规投资项目资本金;部分理财产品信息披露不合规;现场检查配合不力等违法违规事实进行处罚。同日,(银保监银罚决字(2018)13号)对交通银行并购贷款占并购交易价款比例不合规;并购贷款尽职调查和风险评估不到位等违法违规事实进行处罚。

2018年12月7日,中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书(银保监银罚决字(2018)5号),对民生银行贷款业务严重违反审慎经营规则等违法违规事实进行处罚。同日,(银保监银罚决字(2018)8号)对民生银行内控管理严重违反审慎经营规则;同业投资违规接受担保;同业投资、理财资金违规投资房地产,用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资;本行理财产品之间风险隔离不到位;个人理财资金违规投资;票据代理未明示,增信未簿记和计提资本占用;为非保本理财产品提供保本承诺等违法违规事实进行处罚。

2018年12月7日,中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书(银保监银罚决字(2018)10号),对光大银行内控管理严重违反审慎经营规则;以误导方式违规销售理财产品;以修改理财合同文本或误导方式违规销售理财产品;违规以类信贷业务收费或提供质价不符的服务;同业投资违规接受担保;通过同业投资或贷款虚增存款规模等违法违规事实进行处罚。

本基金采用量化的方式进行选股,作为指数增强型基金,在行业权重的偏离上会有一些的控制,银行业在沪深300指数中占很大权重,所以不可避免的选入多家银行,同时我们认为兴业银行(601166)、民生银行(600016)、交通银行(601328)、光大银行(601818)所受处罚并未对其投资价值产生实质性的负面影响,所以依然按照模型选股的结果而没有进行专门的减仓操作。



**8.12.2**

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,911.74
2	应收证券清算款	309,835.69
3	应收股利	-
4	应收利息	30,852.55
5	应收申购款	5,298.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	348,898.68

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明****8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

**8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

**8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份 额比例
中 金 沪 深 300A	238	79,971.79	13,463,376.85	70.74%	5,569,909.53	29.26%
中 金 沪 深 300C	156	13,373.07	-	-	2,086,198.48	100.00%
合计	394	53,602.75	13,463,376.85	63.75%	7,656,108.01	36.25%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额 比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	中金沪深 300A	143,814.88	0.7556%
	中金沪深 300C	4,304.50	0.2063%
	合计	148,119.38	0.7013%

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金 投资和研究部门负责人持 有本开放式基金	中金沪深 300A	10~50
	中金沪深 300C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开 放式基金	中金沪深 300A	0
	中金沪深 300C	0
	合计	0

## 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总 数	持有份额占 基金总份额 比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金 总份额比例（%）	发起份额承诺持 有期限
基金管理 人固有资 金	10,000,000.00	47.35	10,000,000.00	47.35	自基金合同生效 之日起不少于三 年
基金管理 人高级管 理人员	-	-	-	-	-
基金经理 等人员	-	-	-	-	-
基金管理 人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	47.35	10,000,000.00	47.35	-

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金沪深 300A	中金沪深 300C
基金合同生效日（2016 年 7 月 22 日）基金份额总额	10,001,300.00	-
本报告期期初基金份额总额	10,839,298.31	268,832.88
本报告期期间基金总申购份额	10,243,650.31	4,056,377.32
减:本报告期期间基金总赎回份额	2,049,662.24	2,239,011.72
本报告期末基金份额总额	19,033,286.38	2,086,198.48

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人中金基金原董事长林寿康先生离职，2018 年 10 月 18 日起总经理孙菁女士代为履行中金基金董事长（法定代表人）职务。2019 年 1 月 18 日起，楚钢先生担任中金基金董事长（法定代表人）。

2018 年 9 月 3 日起，汤琰女士担任基金管理人中金基金副总经理。

上述重大人事变动情况，本基金管理人均已按照相关规定向监管部门报告并履行信息披露程序。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，基金管理人与股东中金公司就侵犯商标权及不正当竞争事项，联合向南京市中级人民法院起诉，截至报告期末本案尚无判决。

本报告期内无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。本基金本报告期内应支付审计费用 30,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内未受到任何稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
长江证券		290,958,196.26	56.00%	66,677.92	56.14%	-
兴业证券		271,454,799.53	44.00%	52,085.04	43.86%	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面的向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据基金所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金交易单元的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比	成交金额	占当期债 券回购	成交金额	占当期权证 成交总额的

		例		成交总额 的比例		比例
长江证券	1,106,720.00	44.23%	8,400,000.00	100.00%	-	-
兴业证券	1,395,196.30	55.77%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
自有资金	1	2018 年 1 月 1 日-2018 年 12 月 31 日	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	47.35%
产品特有风险							
<p>(1) 标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险</p> <p>标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。</p> <p>(2) 目标指数波动的风险</p> <p>目标指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。</p> <p>(3) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险</p> <p>以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：</p> <p>a. 由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差；</p> <p>b. 由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差；</p> <p>c. 由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差；</p> <p>d. 由于基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差；</p> <p>e. 在本基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度；</p> <p>f. 其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。</p> <p>(4) 目标指数变更的风险</p> <p>尽管可能性很小，但根据基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。</p> <p>(5) 主动增强投资的风险</p> <p>根据本基金的投资策略，为了获得超越指数的投资回报，可以在被动跟踪指数的基础上进行一些优化调整，如在一定幅度内减少或增强成份股的权重、替换或者增加一些非成份股。这种基于对基本</p>							



面的深度研究作出优化调整投资组合的决策，最终结果仍然存在一定的不确定性，其投资收益率可能高于指数收益率但也有可能低于指数收益率。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

中金基金管理有限公司

2019年3月28日